



Disclosure 信息披露

2017年10月20日 星期五
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B75

(上接B74版)

如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金对债券等固定收益类品种的投资比例不低于基金资产的80%,其中对国内有价证券的投资比例不低于固定收益类资产的80%;股票等权益类品种的投资比例不超过基金资产的20%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产的5%。

本基金所指的国内有价证券是指有我国有控股企业发行的债券,包括这类企业所发行的金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转债、分离交易可转债等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

1. 资产配置策略

本基金债券投资将主要采取久期策略,同时辅之以收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过严格的利差分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

2. 债券投资策略

本基金债券投资将主要采取久期策略,同时辅之以收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略,在适度控制风险的基础上,通过严格的利差分析和对利率曲线变动趋势的判断,提高资金流动性和收益率水平,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。

(1) 久期策略

本基金将主要采取久期策略,通过自上而下的组合久期管理策略,以实现对组合利率风险的有效控制;为控制风险,本基金采用以“目标久期”为中心的资产配置方式。目标久期的设定划分为两个层次:战略性配置和技术性配置。“目标久期”的战略性配置由投资决策委员会确定,主要根据对宏观经济和市场短期因素的分析决定组合的目标久期。“目标久期”的技术性配置由基金经理根据市场短期因素的影响在战略性配置预先设定的范围内进行调整;如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,直至接近目标久期上限,以较多地获得债券价格上升带来的收益;反之,如果预期利率上升,本基金将缩短组合的久期,甚至目标久期下限,以减小债券价格下降带来的风险。

(2) 收益率曲线策略
收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的重要依据之一,本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测,适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合,并进行动态调整。

(3) 骑乘策略

本基金采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析,在可选的久期区间内买入期限位于收益率曲线较陡处右侧的债券,在收益率曲线不变动的情况下,随着其期限的衰减,债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑,从而获得较高的资本收益;即使收益率曲线上升或进一步变陡,这一策略也能够提供更为安全的选择。

(4) 息差策略
本基金利用预期利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得的资金投资于债券,利用利差扩大债券投资的收益。

(5) 债券选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合信用等级、流动性,选择投资品种,规避高风险债券,确定其投资价值,选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

(6) 中小企业私募债券
中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让,约定在一定期限还本付息的公司债券,由于其发行门槛及条款可协商性,普遍具有较高的收益。本基金将深入研究发行人资信情况及运营状况,与中小企业私募债券销售商紧密合作,合理合规地精选进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切跟踪债券信用等级及发行人信用等变化情况,力求规避可能存在的债券违约,并获取超额收益。
本基金投资中小企业私募债券,将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

(7) 基金投资策略以精选个股为主,发挥基金管理人专业研究团队的研究能力,考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素,精选流动性好、成长性高、估值水平合理的股票进行投资。

九、基金的业绩比较基准

中债总指数收益率
中债总指数由中央国债登记结算公司编制,并在中国债券网(www.chinabond.com.cn)

公开发布,具有较强的权威性和市场影响力;该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债,能较好地反映债券市场的整体收益。本基金是债券型基金,主要投资于固定收益类金融工具,为此,本基金选取中债总指数作为本基金业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召集基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金属于债券型基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金、高于货币市场基金,为证券投资基金中具有中低风险收益特征的产品。

十一、基金的投资组合报告

本报告期末投资组合符合基金合同约定,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告期内基金资产净值情况
本报告期自2017年4月1日起至6月30日止。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	14,935,914.49	14.59
其中:股票	14,935,914.49	14.59	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	81,620,454.10	79.73
其中:债券	81,620,454.10	79.73	
资产支持证券	-	-	
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	
7	银行存款和结算备付金合计	2,675,145.47	2.61
8	其他资产	3,145,011.48	3.07
9	合计	100,377,425.54	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,397,100.00	6.50
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	193,600.00	0.20
F	批发和零售业	4,761,484.00	4.84
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	913,130.49	0.93
J	金融业	2,111,400.00	2.15
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施服务业	-	-
O	医药、健康和互联网服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	559,200.00	0.57
S	综合	-	-
合计		14,935,914.49	15.18

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:无。

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600153	重庆百货	130000	1,680,900.00	1.71
2	600729	重庆百货	60100	1,613,084.00	1.64
3	600865	百大集团	125000	1,467,500.00	1.49
4	603626	科昌科技	21000	1,368,780.00	1.39
5	002035	华鲁能源	40000	968,000.00	0.98
6	300418	昆仑万维	39927	913,130.49	0.93
7	601628	中国人寿	30000	809,400.00	0.82
8	601688	华泰证券	40000	716,000.00	0.73
9	600419	天狮乳业	12000	601,560.00	0.61
10	604109	国金证券	50000	586,000.00	0.60

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合			
	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,344,867.00	2.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	79,275,587.10	80.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债券(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,620,454.10	82.98

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细					
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122587	PR惠义债	100,000	7,213,000.00	7.33
2	1280287	12柳州债	100,000	6,223,000.00	6.33
3	124261	PR松山投	100,000	6,180,000.00	6.28
4	124060	PR东台投	100,000	6,138,000.00	6.24
5	124088	PR东台债	100,000	6,115,000.00	6.22

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期末未持有国债期货投资。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有国债期货投资。

(3) 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未持有国债期货投资。

10. 投资衍生品情况

(1) 基金投资的衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

(2) 基金投资的衍生品

(3) 其他资产构成

股票代码:000620 股票简称:新华联 公告编号:2017-089

新华联文化旅游发展股份有限公司 关于控股子公司新丝路文旅发行股份购买资产的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、交易概述

新华联文化旅游发展股份有限公司(以下简称“公司”)间接持有的控股子公司新丝路文旅有限公司(证券代码:00472.HK,以下简称“新丝路文旅”)拟通过发行股份购买派生科技集团股份有限公司(以下简称“派生科技”)持有的深圳市你我金融信息服务股份有限公司(以下简称“你我金融”)100%的股权。根据协议约定,新丝路文旅拟每股1.30港币发行1.06亿股作为本次收购对价,最终以1.118亿港元(约合人民币12亿元)进行收购。本次交易完成后,新丝路文旅已发行股份将由3,207,591,674股增至4,293,591,674股。同时,派生科技将持有新丝路文旅25.29%的股份,成为新丝路文旅第二大股东。

本次交易事项尚需提交公司董事会审议,根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《公司章程》等相关规定,本次交易无需提交公司股东大会审议。本次交易事项不构成关联交易,亦不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。

本次发行股份购买资产事宜尚需经香港证券监管机构及新丝路文旅股东大会审议通过后方可实施,如本次交易方案相关事项未获批准,则本次交易将不会实施,交易事项尚存在不确定性。

二、新丝路文旅基本情况
公司名称:新丝路文旅股份有限公司
注册地:百慕大
香港营业地址:香港铜锣湾告士打道262号中银大厦15楼1501-02室
注册资本:16,000万港元
业务性质:投资

股权结构:截至本公告日,新丝路文旅已发行股份总数为3,207,591,674股,公司全资子公司新华联国际置地持有其54.79%的股权,公司与新丝路文旅的股权关系如下:



截至2016年12月31日(经审计),新丝路文旅资产总额303,925.69万元,负债总额216,313.82万元,净资产67,611.87万元,2016年度营业收入为23,986.29万元,净利润-7,514.40万元。

截至2017年6月30日(未经审计),新丝路文旅资产总额284,520.91万元,负债总额56,060.15万元,净资产228,460.76万元,2017年度1-6月营业收入为11,957.56万元,净利润-2,973.53万元。

三、交易对方基本情况

1. 交易对方概况

公司名称:派生科技集团股份有限公司
类型:股份有限公司(非上市、自然人投资或控股)

住所:东莞市南城新城鸿福路102号汇成大厦102A号
法定代表人:唐军
注册资本:100,000万元
统一社会信用代码:91441900581384531E

经营范围:互联网信息服务,商务信息咨询,企业管理咨询,代办银行贷款手续,投资咨询,资产管理,项目投资。

四、上市公司认为必要的风险提示

公司郑重提醒广大投资者,有关公司信息以公司在上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)和公司指定信息披露媒体《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》刊登的相关公告为准,敬请广大投资者理性投资,注意投资风险。

特此公告。

甘肃国芳工贸(集团)股份有限公司董事会
2017年10月20日

证券代码:600711 证券简称:盛屯矿业 公告编号:2017-093

盛屯矿业集团股份有限公司 关于实际控制人部分股票 解除质押的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

盛屯矿业集团股份有限公司(以下简称“公司”)于近日获悉,实际控制人姚雄杰先生将其持有的公司部分股票解除质押,具体情况如下:

2017年10月18日,姚雄杰先生于国金证券股份有限公司质押的20,090,000股股票(股票代码:600711)解除质押手续,并于2017年10月18日办理完毕上述股票的解除质押登记手续。本次解除公司股票数量占其所持有公司股票总数的20.06%,占公司总股本1.34%。

截止本公告日,姚雄杰先生持有公司股票100,152,393股(其中姚雄杰先生直接持有81,261,470股,通过金鼎基金-招商银行-金鼎基金金鼎2号资产管理计划持有18,890,923股),占公司总股本6.60%,本次股票解除质押后,剩余质押股份合计20,866,470股,质押股份数量占其所持有公司股票总数的20.83%,占公司总股本1.39%。

特此公告。

盛屯矿业集团股份有限公司
董 事 会
2017年10月20日

证券代码:002070 证券简称:“ST众和” 公告编号:2017-091

福建众和股份有限公司 关于延期披露2017年 第三季度报告的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

福建众和股份有限公司(以下简称“公司”)原计划于2017年10月26日披露2017年第三季度报告,鉴于近期公司业务繁忙,预计无法于原定时间披露第三季度报告,经申请,公司2017年第三季度报告披露时间将延期至2017年10月31日。

公司董事会对本次调整披露时间给投资者带来的不便深表歉意,敬请投资者谅解。

特此公告。

福建众和股份有限公司
董 事 会
二〇一七年十月二十日

股票简称:天马科技 股票代码:603668 公告编号:2017-063

福建天马科技集团股份有限公司 关于公开发行可转换公司债券 申请材料获中国证监会受理的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

福建天马科技集团股份有限公司(以下简称“公司”)于2017年10月18日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)出具的《中国证监会行政许可申请受理通知书》(172072号),中国证监会依法审查了公司提交的《上市公司发行可转换公司债券募集说明书》行政许可申请材料,认为该申请材料齐全,符合法定形式,决定受理该行政许可申请。

截止本公告日,公司已按照《上市公司发行可转换公司债券募集说明书》的要求,编制了《上市公司发行可转换公司债券募集说明书》,并经会计师事务所审计,符合发行条件,决定受理该行政许可申请。

特此公告。

福建天马科技集团股份有限公司
董 事 会
二〇一七年十月十九日

证券代码:300353 证券简称:东土科技 公告编号:2017-094

北京东土科技股份有限公司 2017年第三季度报告披露 提示性公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

北京东土科技股份有限公司(2017年第三季度报告)已于2017年10月20日在中国证监会指定创业板信息披露网站披露,敬请投资者查阅。

北京东土科技股份有限公司
董 事 会
2017年10月20日

证券代码:002021 证券简称:中捷资源 公告编号:2017-059

中捷资源投资股份有限公司 关于变更保荐机构及保荐代表人的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

2015年12月4日,中捷资源投资股份有限公司(以下简称“公司”)与浙商证券股份有限公司(以下简称“浙商证券”)签订了《关于终止持续督导工作的协议》,同时,公司与新时代证券股份有限公司(以下简称“新时代证券”)签订了《关于中捷资源投资股份有限公司2017年公开发行股票及2014年非公开发行股票之持续督导协议》,聘请新时代证券担任公司2015年非公开发行股票的保荐人(含主承销商)。

此外,因公司筹划2015年非公开发行股票工作,2015年12月4日,公司与新时代证券签订了《关于中捷资源投资股份有限公司非公开发行股票之保荐协议》和《关于中捷资源投资股份有限公司非公开发行股票之保荐协议》,聘请新时代证券担任公司2015年非公开发行股票的保荐人(含主承销商)。

公司非公开发行股票申请于2016年11月16日经中国证监会证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)第164次发行审核会议审议通过,但尚未取得中国证监会书面核准批复文件,为了保证本次非公开发行股票的顺利发行,公司另行聘请新时代证券股份有限公司及主承销商。

2017年10月17日,公司与新时代证券签署了《中捷资源投资股份有限公司与新时代证券股份有限公司之保荐协议》、《承销协议》、《持续督导协议》及《终止协议》。

2017年10月18日,公司与新时代证券股份有限公司(以下简称“新时代证券”)签署了《中捷资源投资股份有限公司与新时代证券股份有限公司签订的持续督导协议》、《中捷资源投资股份有限公司与新时代证券股份有限公司签订的持续督导协议》、《中捷资源投资股份有限公司与新时代证券股份有限公司签订的持续督导协议》。

根据公司与新时代证券签署的相关协议,新时代证券将承接对公司2017年公开发行股票及2014年非公开发行股票募集资金管理使用的持续督导工作,新时代证券委派保荐代表人杨科先生、尤存武先生(简历附后)负责具体的持续督导工作;同时,新时代证券将担任公司向中国证监会申请非公开发行股票

的保荐人及主承销商。

支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第三-7项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(四)与销售有关的费用
本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费。

养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老金等,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户适用于特定申购费率,其他投资者申购本基金基金份额适用于一般申购费率,具体费率见下表:

申购金额(M元)	一般申购费率	特定申购费率
M<100万	0.8%	0.32%
100万≤M<500万	0.4%	0.12%
500万≤M	每笔1000元	每笔1000元

本基金的基金赎回费用在投资人申购基金份额时收取。投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔计算。

申购费用由投资人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2. 赎回费率
本基金的赎回费率如下表所示:

持有时间(Y)	赎回费率
Y<7天	1.50%
7天≤Y<30天	0.75%
30天≤Y<3个月	0.5%
3个月≤Y<6个月	0.3%
6个月≤Y<2年	0.1%
Y≥2年	0

注:赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取,对持续持有期少于3个月的投资者收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期长于3个月的投资者收取的赎回费总额的50%计入基金财产。

(五) 不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:

1. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3. 《基金合同》生效前的相关费用;

4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(六) 基金管理人及基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费和基金托管费。基金管理人必须最迟于新的费率实施前2日前在指定媒体上刊登公告。

(七) 基金税收
本基金运作过程中涉及的各项纳税,其纳税义务按照国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明
本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的规定,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人原公告的本基金招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1. 在“重要提示”部分明确了更新招募说明书内容的截止日期和有关财务数据的截止日期。

2. 在“第三部分 基金管理人”部分内容进行了更新。

3. 在“第四部分 基金托管人”部分内容进行了更新。

4. 在“第七部分 基金份额的申购与赎回”部分内容进行了更新。

5. 在“第八部分 基金投资”部分内容进行了更新。

6. 在“第九部分 基金业绩”部分内容进行了更新。

7. 在“第十部分 基金份额持有人的服务”部分内容进行了更新。

8. 在“第二十一部分 其他披露事项”部分内容进行了更新。

新华联文化旅游发展股份有限公司
2017年10月